信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）招募说明书摘要

（2016年第2次更新）

基金管理人：信诚基金管理有限公司
基金托管人：中国银行股份有限公司
重要提示

本基金于2012年5月7日基金合同正式生效。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为2016年11月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：信诚基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人：张翔燕

成立日期：2005年9月30日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142号

注册资本：2亿元

电话：（021）6864 9788

联系人：唐世春

股权结构：

股 东	出资额（万元人民币）	出资比例（%）
中信信托有限责任公司	9800	49
英国保诚集团股份有限公司	9800	49
中新苏州工业园区创业投资有限公司	400	2
合 计	20000	100

（二）主要人员情况

1、董事会成员

张翔燕女士，董事长，硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理，中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理，中信证券股份有限公司副总经济师，中信控股有限责任公司风险管理部总经理、中信控股有限责任公司副总裁、中国中信集团有限公司业务协同部主任，现任中信信托有限责任公司副董事长、中信信诚资产管理有限公司（信诚基金管理有限公司之子公司）监事。

王道远先生，董事，工商管理硕士。历任中信信托有限责任公司综合管理部总经理、信托管理部总经理、总经理助理、董事会秘书、副总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理、董事会秘书、固有业务审查委员会主任兼天津信崇货币经纪有限责任公司董事长。

Guy Robert STRAPP先生，董事，商科学士。历任瀚亚投资（香港）有限公司首席执行官，英国保诚集团亚洲区资产管理业务投资总裁、瀚亚投资（新加坡）有限公司首席执行官。现任瀚亚投资集团首席执行官兼瀚亚投资（香港）有限公司首席执行官。

魏秀彬女士，董事，新加坡籍，工商管理硕士。历任施罗德国际商业银行东南亚区域合规经理、施罗德投资管理(新加坡)有限公司亚太地区风险及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官。

吕海先生，董事，总经理，工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司（中信证券股份有限公司的全资子公司，2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并）总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理有限公司副总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

孙麟麟先生，独立董事，商科学士。历任安永会计师事务所（香港）资产管理审计团队亚太区联合领导人，安永会计师事务所（旧金山）美国西部资产管理市场审计团队领导等职。现任Lattice Strategies Trust 独立受托人、Nippon Wealth Bank 独立董事、Ironwood Institutional Multi Strategy Fund LLC and Ironwood Multi Strategy Fund LLC 独立董事。

夏执东先生，独立董事，经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华会计师事务所首席合伙人。现任致同会计师事务所管委会副主席。

杨思群先生，独立董事，经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员，现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

注：原“英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务”自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资，其旗下各公司名称自该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

2.监事

於乐女士，执行监事，经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行营业管理部主管、通用电气金融财务（中国）有限公司人力资源经理。 现任信诚基金管理有限公司首席人力资源官。

3.经营管理层人员情况

吕海先生，董事，总经理，工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司（中信证券股份有限公司的全资子公司，2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并）总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理有限公司副总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

桂思毅先生，副总经理，工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计员，中乔智威汤逊广告有限公司财务主管，德国德意斯登银行上海分行财务经理，信诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席财务官。

唐世春先生，副总经理，法学硕士。历任北京天平律师事务所律师、国泰基金管理有限公司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书；信诚基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、中信信诚资产管理有限公司董事。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

陶晓炜先生，副总经理，经济学硕士，注册会计师。历任中信证券股份有限公司高级经理、中信控股有限责任公司高级经理、信诚基金管理有限公司首席市场官、首席运营官。现任信诚基金管理公司副总经理，兼任中信信诚资产管理有限公司董事、总经理。

4.督察长

周浩先生，督察长，法学硕士，历任中国证券监督管理委员会主任科员、公职律师、副调研员，上海航运产业基金管理有限公司合规总监，国联安基金管理有限公司督察长。现任信诚基金管理有限公司督察长。

5、基金经理

张光成先生，工商管理硕士，CFA。曾任职于欧洲货币(上海)有限公司，担任研究总监；于兴业全球基金管理有限公司，担任基金经理。2011年7月加入信诚基金管理有限公司，历任投资经理，信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。现任股票投资总监，信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）、信诚幸福消费混合型证券投资基金的基金经理。

6、投资决策委员会成员

胡喆女士，总经理助理、副首席投资官、特定资产投资管理总监；

董超先生，交易总监；

张光成先生，股票投资总监、基金经理；

王睿先生，研究副总监、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2016年6月30日，中国银行已托管502只证券投资基金，其中境内基金471只，QDII基金31只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2016年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、场外发售机构

（1）直销机构

名称：信诚基金管理有限公司及本公司的网上交易平台

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层

法定代表人：张翔燕

电话：（021）6864 9788

联系人：陈强投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：www.xcfunds.com

（2）代销机构

1）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

联系人：刘岫云

客服电话：95566

传真：010-66594907

电话：010-66594977

网址：www.boc.cn

2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心

法定代表人：王洪章

电话：010-67596219

传真：010-66275654

联系人：张静

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

3）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

网址：http://bank.ecitic.com

4）中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

联系人：刘峰

电话：010-85108226

传真：（010）85109219

客服电话：95599

网址：www.95599.cn

5）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：张宏革

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

6）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83077278

传真：0755-83195049

联系人：邓翀鹏

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

7）宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号

法定代表人：陆华裕

客户服务统一咨询电话：96528，上海地区：962528

网址：www.nbcb.com.cn

联系人：胡技勋

联系方式：0574-89068340

传真：0574-87050024

8）华夏银行股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

法定代表人：吴建

联系人：马旭

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

9）东莞银行股份有限公司

注册地址：广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

办公地址：广东省东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

法定代表人：廖玉林

联系人：胡昱

联系人：陈幸

电话：0769-22119061

传真：0769-22117730

统一客户服务电话：0769-96228

公司网站：www.dongguanbank.cn

10）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座（邮编：518048）

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

传真：0755-23835861、010-60836029

网址：http://www.cs.ecitic.com

11）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

联系人：魏明

联系电话：(010)85130579

联系电话：010-85156398

开放式基金咨询电话：4008888108

网址：www.csc108.com

12）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

电话：0755-23953913

网址：http://www.citicsf.com/

13）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层（266061）

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

14）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第4、18层至21层

法定代表人：龙增来

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

统一客户服务电话：400-600-8008 、95532

公司网站：www.china-invs.cn

15）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：（0755）82943636

网址：www.newone.com.cn

客服电话：95565、4008888111

16）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层

法人代表人：何如

联系电话：0755－82130833

基金业务联系人：李颖

联系电话：0755-82133066

传真：0755－82133952

全国统一客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

17）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553或4008888001

联系人：李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021－23219100

网址：www.htsec.com

18）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：021-33388211

传真：021-33388224

客服电话：95523或4008895523

网址：www.swhysc.com

19）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

20）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅崴

电话：021－38676767

客户服务热线：400-8888-666 / 95521

21）广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

联系人：黄岚

联系电话：020-87555888-8333

统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点

开放式基金业务传真：（020）87555305

公司网站：广发证券网 www.gf.com.cn

22）华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福建省福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：郭相兴

联系电话：021－20655175

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）。

公司网址：www.hfzq.com.cn

23）西藏同信证券股份有限公司

注册地址：拉萨市北京中路101号

办公地址：上海市永和路118弄东方环球企业园24号

法定代表人：贾绍君

联系人：汪尚斌

电话：021-36537114

传真：021-36538467

统一客户服务电话：4008811177

24）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号（200040）

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：021-22169081

传真：021-22169134

客户服务电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

25）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82558305

客服电话：95517

公司网站：www.essence.com.cn

26）中泰证券股份有限公司（齐鲁证券）

注册地址：山东省济南市经十路20518号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-81283900

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn/

27）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579或4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

长江证券客户服务网站：www.95579.com

28）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

联系电话：021-63325888

客服电话：95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

29）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

联系人：周一涵

电话：021-38637436

全国免费业务咨询电话：95511-8

开放式基金业务传真：0755-82400862

全国统一总机：95511-8

网址：stock.pingan.com

30）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券1号楼6层2区

法定代表人：吴万善

联系人：庞晓芸

联系电话：0755-82492193

客服电话：95597

31）天相投资顾问有限公司（简称“天相投顾”）

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编：100032

办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层 邮编：100088

法定代表人：林义相

联系人：尹伶

联系电话：010-66045608

客服电话：010-66045678

传真：010-66045521

天相投顾网址：http://www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

32）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：鹿馨方

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

33）申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）

法定代表人：韩志谦

电话：0991-2307105

传真：0991-2301927

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

联系人：李巍

34）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40/42层

法定代表人：卢长才

联系人：陈玮

电话：0755-83199599

传真：0755-83199545

网址：www.csco.com.cn

35）红塔证券证券有限责任公司

注册地址：云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

联系人：高国泽

联系电话：0871-63577946

传 真：0871-3578827

客服电话：4008718880

网址：www.hongtastock.com

36）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘洋

联系电话：0755-83516289

客服电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

37）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：徐汇区龙田路195号3C座10楼

法定代表人：其实

电 话：021-54509998

传 真：021-64385308

公司网址：www.1234567.com.cn

客服电话：400-1818-188

38）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118号903-906室

法定代表人：杨文斌

联系电话：021-20613999

传真：021-68596916

公司网址：www.howbuy.com

客服电话：400-700-9665

39）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

电话：021-20691832

传真：021-20691861

公司网站：www.erichfund.com

客服电话：400-089-1289

40）深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

公司网址：www.zlfund.cn

客服电话：4006-788-887

41）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F

法定代表人：王莉

联系电话：010—85650628

传真：010-65884788

官网网址：www.licaike.com

客服电话：400-920-0022

42）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室

办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼

法定代表人：张慕

电 话：021-33323998

传 真：021-33323993

网址：fund.bundtrade.com

客户服务电话：400-820-2819

43）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

电 话：0571-88911818

传 真：0571-86800423

公司网站：www.5ifund.com

客服电话：4008-773-772

44）上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼

法定代表人：燕斌

电 话：021-51507071

传 真：021-62990063

网址：www.66zichan.com

客服电话：4000-466-788

45）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼

法定代表人：肖雯

电 话：020-89629021

传 真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

客户服务电话：020-89629066

46）北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A

法定代表人：梁蓉

电话：010-66154828

传真：010-88067526

网址： www.5irich.com

客户服务电话：400-6262-818

47）北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人：董浩

电话：010-65409010

网址：www.jimufund.com

客户服务电话：400-068-1176

48）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人：郭坚

电话：021-20665952

传真：021-22066653

网址： www.lu.com

客户服务电话：4008219031

49）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人： 陈继武

电话：021-63333389

网站：www.lingxianfund.com

客户服务电话：4000178000

50）大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址：上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人：袁顾明

电话：021-22267995

传真：021-22268089

网站：www.dtfunds.com

客户服务电话：4009282266

51）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

法定代表人：罗昶安

电话：010-67000988-6003

传真：010-67000988-6000

网址： www.zcvc.com.cn

客户服务电话：400-001-8811

52）名称：上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：沈继伟

电话：021-50583533

传真：021-50583633

网址：www.leadfund.com.cn

客户服务电话：400-067-6266

53）北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱SOHO 1008-1012

法定代表人：赵荣春

电话：010-59158281

传真：010-57569671

网址：www.qianjing.com

客户服务电话：400-893-6885

54）上海云湾投资管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人：王爱玲

电话：021-68783068

传真：021-20539999

官网网址：www.zhengtongfunds.com

客服电话：400-820-1515

55）北京隆观天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层

法定代表人：蒋煜

联系电话：010-58170949

官网地址：www.shengshiview.com

客服电话：400-818-8866

56）奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室，1116室及1307室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系电话：021-20567288

传真：0755-21674453

公司网址： www.ifastps.com.cn

客服电话： 400-684-0500

57）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街11号1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街11号1108

法定代表人：王伟刚

联系电话：010-56282140

公司传真：010-62680827

官网网址：www.fundzone.cn

客服电话：400-068-1176

58）浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

联系电话：0571-88337717

公司传真：0571-88337666

官网网址：www.jincheng-fund.com

客服电话：400-068-0058

59）杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心1604室

办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20F

法定代表人：陈刚

联系电话：0571-85267500

公司传真：0571-8526 9200

官网网址：www.cd121.com

客服电话：0571-86655920

60）泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客服电话：4006411999

公司网站：www.taichengcaifu.com

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

2、场内发售机构：深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

办公地址：北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层

法人代表：姚建华

经办注册会计师：王国蓉、黄小熠

电话：8621 2212 2888

传真：8621 6288 1889

联系人：王国蓉

四、基金的名称

信诚周期轮动混合型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

契约型、开放式

六、基金的投资目标

在深入分析经济发展规律的基础上，本基金根据行业与宏观经济的联动特点，动态调整行业及个股配置比例，在严格控制风险并保证流动性的前提下，力求基金资产的长期稳定增值。

七、基金的投资范围和投资比例

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、银行定期存款、中期票据、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-95%；债券、中期票据、资产支持证券、银行定期存款等固定收益类证券品种占基金资产的比例不超过40%；现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证不超过基金资产净值的3%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

八、基金的投资策略

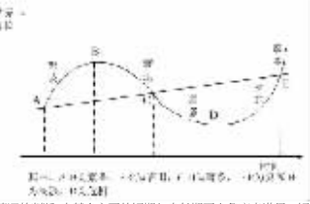
1、资产配置策略

经济在发展过程中反复出现的整体扩张与收缩的过程被称为经济周期。根据经济周期理论，经济发展可以被分为繁荣、衰退、萧条与复苏四个阶段（见表1、图1）。本基金从经济增长趋势、通货膨胀趋势两个维度来判断经济周期所处的阶段，结合各类资产与宏观经济的联动性，对权益类、固定收益类资产进行配置。

表1、各经济阶段的特征

经济阶段	特征
繁荣	经济扩张、通货膨胀上升
衰退	经济收缩、通货膨胀上升
萧条	经济收缩、通货膨胀下降
复苏	经济扩张、通货膨胀下降

图1、各经济阶段的划分



对于经济增长情况的判断，本基金主要从短期与中长期两个角度来进行。短期中，本基金通过宏观经济增长指标的变动趋势进行判断，主要参考指标有：工业增加值、GDP增速、发电量等；中长期中，本基金通过对推动经济发展的主要动力在中长期的变动趋势进行判断，主要参考指标有：居民收入变化、投资（尤其是固定资产投资）的变化、出口结构的变化、政府的政策导向等。对于通货膨胀的判断，本基金主要通过居民消费价格指数、生产者价格指数及GDP平减指数等进行判断。

在经济处于最高点附近，由繁荣逐步转向衰退时，通货膨胀率一般较高、利率高企，上市公司成本高企、生产能力下降、盈利下降，收益率曲线上行且呈现平坦化、债券收益率表现较差，本基金将在符合基金合同规定的前提下适度增加现金资产的配置比例；

在经济处于衰退期时，经济增速下滑，企业盈利下滑且实际收益率下降，中央银行开始下调利率，从而导致收益率曲线下行且呈现陡峭化，债券收益率相对较好，此时本基金将增加债券的配置比例；

当经济经过萧条期，开始逐步复苏时，经济刺激政策开始奏效，企业盈利开始逐步转好，通货膨胀率保持低位，权益类资产表现较好，本基金将增加权益类资产的投资比例。

2、股票投资策略

本基金采取行业指导下的个股精选方法。即：首先结合宏观经济发展情况，在严格控制风险的前提下，对周期类行业与稳定类行业进行配置；在此基础上确定周期类行业与稳定类行业内各行业配置情况；最后分别对周期类行业、稳定类行业内个股进行评估，从而精选基本面良好的个股以构建股票投资组合。

（1）行业配置策略

1）周期类行业与稳定类行业的配置

本基金采用申银万国行业分类一级行业分类标准，并根据各行业与宏观经济联动性的分析，将各行业归入周期类行业与稳定类行业两大类。所谓周期类行业，指与宏观经济联动性大，盈利随经济周期波动呈现周期性波动的行业。相应的，稳定类行业指与宏观经济联动性相对较小，盈利在经济周期中波动较小的行业。

在经济萧条阶段，企业生产能力下降，整体需求随之下降，稳定类行业由于需求弹性小，其行业内企业盈利受宏观经济影响相对较小，业绩表现较好，本基金将给予适度超配；

在经济的复苏阶段，利率水平一般较低，货币供给充足，企业生产能力逐步回升、需求量上升，周期类行业由于对需求较为敏感，其盈利能力回升，业绩相对较好，本基金将予以适度超配；

在经济繁荣阶段与衰退阶段，影响两大类行业盈利的因素较多，本基金将主要关注周期类与稳定类行业收益于未来中短期宏观经济中的发展趋势、同时结合政府的政策、行业结构、近期市场表现等因素，综合评估周期类与稳定类行业的投资价值，对看好的行业进行适度超配。

2）周期类行业与稳定类行业内各行业的配置

鉴于周期类行业与宏观经济联动性强，随着宏观经济的发展呈现周期性的轮动，本基金将同时兼顾行业与经济周期的联动性及其基本面；鉴于稳定类行业与宏观经济联动性较弱，在经济周期各阶段表现相对稳定，本基金在对稳定类行业内将重点分析行业基本面。

A、周期类行业内各行业的配置

根据周期类行业的特点，本基金通过定性与定量分析，对周期类上游行业（有色金属、采掘）、周期类中游行业（黑色金属、建筑建材、机械设备、化工）、周期类下游行业（交通运输、交运设备）、大金融类行业（金融服务、房地产）等四大类行业，进行行业配置。

a、定性分析

定性分析主要考量经济增长趋势、通货膨胀趋势两方面。

根据经济周期理论，当经济处于最低点时，通货膨胀率与经济增速都处于加速下降时期，上市公司估值处于见底过程中，需求相对较为稳定的周期类下游行业值得关注；当经济处于复苏初期时，通货膨胀率加速下降、经济增速开始上升、利率也一般较低，需求开始恢复。因此需求弹性较大的周期类上游行业以及利率敏感性强的大金融类行业值得关注；当经济处于复苏中期、繁荣初期时，周期类下游行业、中游行业开始逐步复苏，本基金将进行关注；当经济处于最高点时，通货膨胀率加速上升、经济增速加速上升，周期类上游行业及部分中游行业（例如，黑色金属、机械设备）等业绩表现相对较好，本基金将进行关注；在衰退初期、中期、末期，由于经济增速开始下滑，对其敏感的周期类行业盈利下降明显，本基金将在符合基金合同规定的投资比例的条件下，降低周期类品种的配置。

b、定量分析

本基金将通过P/E、P/B的纵向（与同行业历史数据对比）与横向（与不同行业同期数据对比）比较，评估周期类行业内四大类行业的估值水平；通过销售增长率、净资产收益率、净利润增长率等评估上述四大类行业的盈利状况；通过流动比率、速动比率、资产负债率等评估四大类行业的偿债能力；通过对上述大类行业近期相对大盘涨幅、相对大盘换手率，评估四大类行业近期市场表现。

B、稳定类行业内各行业的配置

a、定性分析

本基金将从基本面与成长性两个方面，对稳定类行业内各行业进行定性角度的分析。在基本面方面，将对行业产业结构、行业生命周期、在经济周期中的景气度等因素进行分析；在成长性方面，将对国家政策导向、技术经济效益、行业相对竞争优势等因素进行分析。

b、定量分析

本基金将通过P/E、P/B的纵向（与同行业历史数据对比）与横向（与不同行业同期数据对比）比较，评估稳定类行业内各行业估值水平